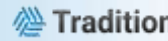


Market Daily Report

2024.10.07(월)



레포	차주 지준 잉여 마감 우려 확대되어 은행권 조달 보다는 운용에 집중했으며, 운용사 및 신탁 자금 풍부하여 금리 추가 하락하였음. 장 중 잉여세 심화되어 매수자금 대기했고, 한은RP매각 증액했음에도 추가 매도 많지 않아 저금리 매칭되었음.
채권	한국 : 국제금리는 상승 마감. 휴일 간 미국 국제금리가 오른 데 영향을 받았음. 외국인도 국제선물을 대거 매도해 약세 압력을 가함. 장중 미 국제 움직임에 민감하게 반응하며 변동성을 보임. 이날 밤 미국 고용보고서 공개를 앞두고 단서를 찾으려는 움직임으로 풀이됨. 미국 : 미 국제금리는 모두 상승 마감. 9월 비농업 신규 고용이 전월비 25만 4천명 증가하며 시장 예상치인 14만 7천명을 크게 상회. 9월 실업률도 4.1%를 기록하며 전월비와 비교해도 둔화했고 예상치도 하회. 앞서 두 달 간의 신규 고용 인원도 크게 상향 조정 되면서 연준의 금리인하 속도가 느려질 것이라는 전망으로 이어짐. 일각에선 1월 연준 금리 동결 의견도 등장.
MONEY	10/4 머니 시장은 역외의 공격적인 오피 공세 속 월초 유동성이 여유로워 비드는 소극적인 반응에 따라 전테너 레벨은 하향 추세를 보이고 있음. 1개월물 오피는 4.92-4.95 사이로 제시 중이며, 역외 오피로 3개월물 5.00 6개월물 4.70 9개월물 4.65 1년물 4.40 까지 중국계 및 대만계로 제시 되면서 다음주 10/8 (스팟 벨류) 중국 시장이 오피 할 것을 감안 중국 역외 센터 위주로 가격 태핑중. 온쇼에서는 연넘기는 구간 3개월물 4.98-5.00 사이로 오피 제시로 말레이시아와 대만계 네임으로 일부 매칭 되었음. 다음주 중국 본토에서 휴장 이후 쌓아둔 자금 운용 개시 할 경우 연말 커버 구간 3개월물 레벨이 어느정도 형성 될지 그리고, 연휴 이후 중국계 은행들의 자산 매칭 포지션이 얼마나 등장할지 여부에 따라 3개월물 5% 전후로 (3m Sofr+35-40bp) 유지 될지가 관건.
FX SWAP	미국의 9월 비농업 신규 고용이 전월보다 늘어난 것으로 집계. 9월 실업률은 4.1%로 0.1%포인트로 내림, 전월치와 비슷. 예상보다 크게 개선된 고용지표에 연준(Fed)의 빅컷 기대감은 사라짐. 미국 국제금리도 금리인하 기대가 후퇴하면서 금등, 저변주 금요일 스팟의 금등적 요인은 특별한 이벤트라기 보다 엔화, 위안화 등 다른 통화 모두 상승방향과 맞물린 지점으로 보여짐. 또한, 지정학적 리스크가 아직 해소 안 된 상황.
IRS	전일 IRS는 중동발 분쟁으로 이스라엘 보복 공격 가능성이 높아지면서 국제선물이 약세를 보임에 따라 상승 마감. 초반에는 2년과 9개월쪽으로 호가 형성되었으며 2년이 87.5-88에 몇 차례 거래가 이뤄졌고 2년 오피가 다소 많이 보였으며 9개월은 21.5에 거래된 후 오피가 21.25까지 내려옴. 이후에는 5*10년이 5.25/5를 이루다 5.25에 거래되었고 1.5년 96 마켓 거래 소식으로 커버가 움직이면서 전체적으로 커버가 스틱되는 모습을 보임. 막판에는 10년 오피와 2년 오피가 85, 88로 내려왔으며 1년이 9.25에 거래가 이뤄짐. 마감 이후에는 9개월이 22.25에 초이스를 이뤘으며 2년 비드가 88.25로 올라오면서 거래되는 모습을 보임.

단기자금시장						전일 미국 국제 금리			
레포 거래잔액	MMF 잔고	레포금리	풀금리(C2)	기준금리	CD(91일)	금리		전일대비	
2024.09.26(목)	222.1	185.5	3.53%	3.531%	3.500%	3.53%	2년물	3.926%	21.9
2024.09.27(금)	223.7	184.6	3.55%	3.535%		3.53%	5년물	3.806%	17.7
2024.09.30(월)	226.9	176.2	3.58%	3.602%		3.53%	10년물	3.969%	12.1
2024.10.02(수)	227.0	178.9	3.48%	3.510%		3.52%	30년물	4.252%	7.3
2024.10.04(금)	223.9		3.45%	3.494%		3.52%	10Y-2Y	4.3	-9.8

국내 금융시장 동향			전일 외국인 순매수 순매도			오늘의 채권		
항목	지표	전일대비	만기	종목	금액	채권 발행	채권 만기	채권 입찰
KOSPI	2,569.71	8.02	25.10.02	통안채	1,200	은행채 3,000	은행채 10,900	국고채 30년 20,000억원 입찰
KOSDAQ	768.98	6.85	29.09.10	국고 24-7	912	여전채 1,600	여전채 6,500	통안채 91일물 8,000억원 입찰
달러-원	1,349.30원	26.30원	32.06.10	국고 22-5	500	회사채 7,000	회사채 6,900	
국고3Y	2.824%	4.4	51.03.10	국고 21-2	-518	공사채 8,200	공사채 9,300	
국고10Y	2.996%	6.4	27.06.10	국고 17-2	-1,500			
국고10Y-3Y	17.2	2	26.09.10	국고 21-7	-4,187			

Money Market Closing									
기간	KOREAN/FOREIGN		증가	전일대비	기간	CHINESE		증가	전일대비
O/N	4.90	4.82	4.85	-0.01	O/N	4.88	4.83	4.85	0.00
TN	4.91	4.83	4.87	0.00	TN	4.88	4.83	4.85	-0.03
1W	4.96	4.86	4.91	0.00	1W	4.90	4.85	4.88	-0.04
1S	5.00	4.90	4.95	0.00	1S	5.05	4.95	5.03	-0.02
3S	5.05	4.90	4.98	0.00	3S	5.05	4.90	5.00	-0.02
6S	4.80	4.55	4.65	-0.10	6S	4.80	4.60	4.70	-0.05
1YR	4.60	4.15	4.40	-0.05	1YR	4.60	4.30	4.40	-0.15

FX SWAP CLOSING						ND SPREAD			
기간	BID/OFFER	CLOSING	USD환산금리	전일대비	KORIBOR	SOFR	TENOR	BID	OFFER
O/N	-22/-18	-20	5.30	0.16	3.50	4.92000	1M MAR	-243	-241
TN	-9/-5	-7	5.39	-0.39	3.50	4.91777	1W*1S	-182	-175
1W	-60/-56	-58	5.73	0.05	3.50	4.90437	1*2	-205	-195
1S	-255/-245	-250	5.68	-0.02	3.49	4.85077	1*3	-455	-445
3S	-735/-715	-725	5.64	0.07	3.48	4.58972	1*6	-930	-910
6S	-1290/-1230	-1260	5.33	0.05	3.41	4.27362	1*9	-1350	-1330
1YR	-2070/-1970	-2020	4.78	0.04	3.23	3.83337	1*12	-1650	-1630

국내외 일정	
FOMC	1.30~1.31 / 3.19~3.20 / 4.30~5.1 / 6.11~6.12 / 7.30~7.31 / 9.17~9.18 / 11.6~11.7 / 12.17~12.18D
금통위	1.11(목) / 2.22(목) / 4.12(금) / 5.23(목) / 7.11(목) / 8.22(목) / 10.11(금) / 11.28(목)
지준일	1.10(수) / 2.7(수) / 3.6(수) / 4.10(수) / 5.8(수) / 6.5(수) / 7.10(수) / 8.7(수) / 9.11(수) / 10.9(수) / 11.6(수) / 12.11(수)

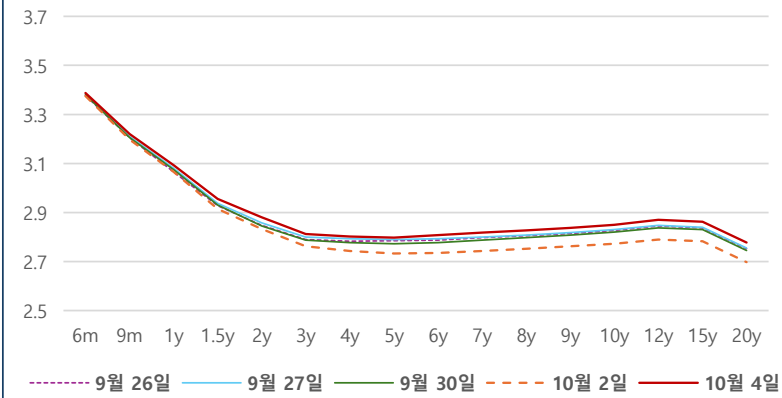
IRS 데일리 증가

10월 4일

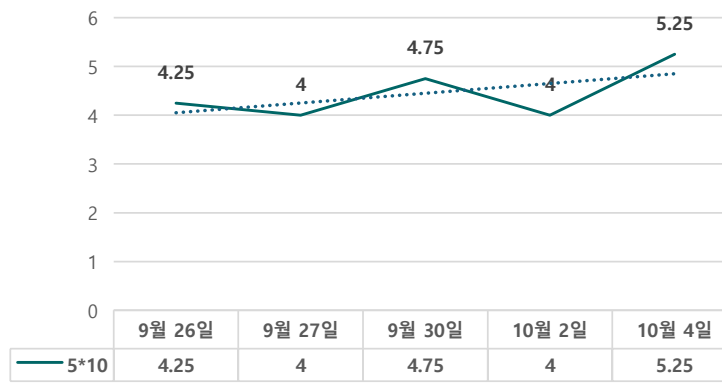
단위 : %, bp

구분	증가	전일대비
6m	3.3875	1.25
9m	3.2200	2.25
1y	3.0925	2.75
1.5y	2.9550	4.00
2y	2.8800	4.75
3y	2.8125	5.00
4y	2.8025	6.00
5y	2.7975	6.50
6y	2.8075	7.25
7y	2.8175	7.50
8y	2.8275	7.50
9y	2.8375	7.50
10y	2.8500	7.75
15y	2.8625	8.00
20y	2.7775	8.00

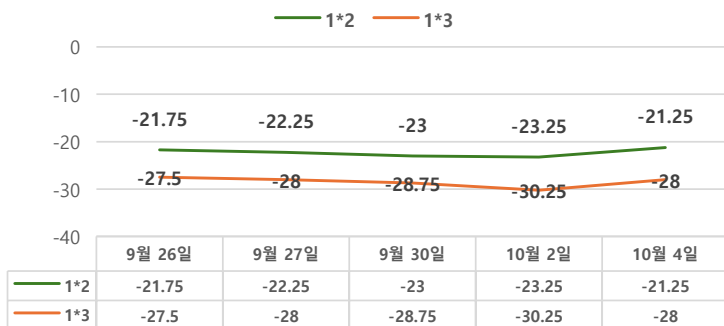
IRS 증가



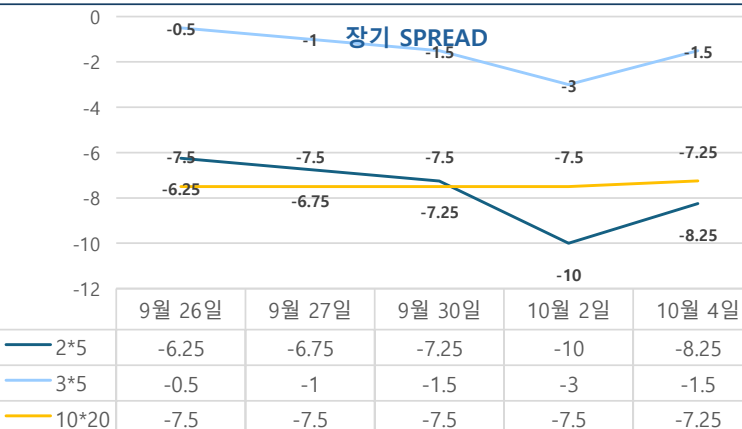
5*10 SPREAD



단기 SPREAD



장기 SPREAD

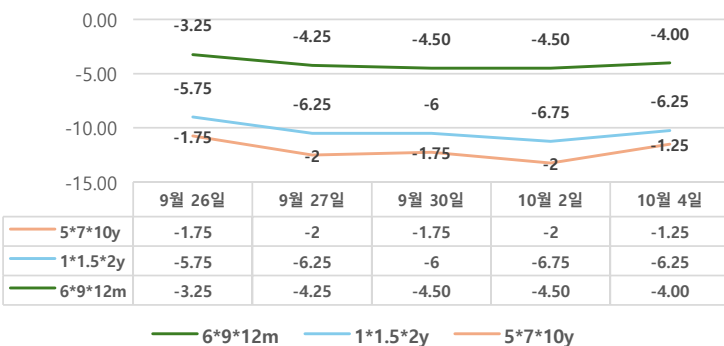


IRS 주요 커브

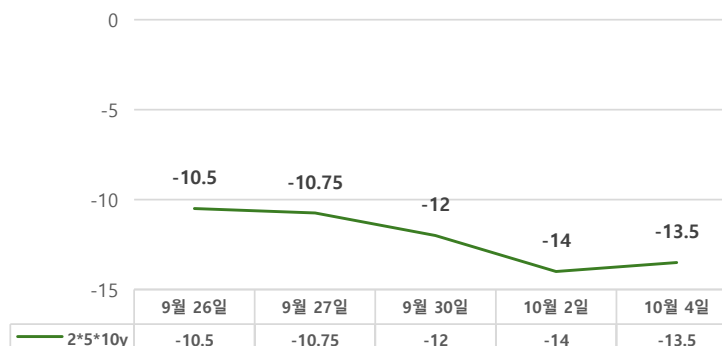
SPREAD

구분	증가	전일대비
1*2y	-21.25	2.00
1*3y	-28.00	2.25
2*5y	-8.25	1.75
3*5y	-1.50	1.50
5*10y	5.25	1.25
10*20y	-7.25	0.25

주요 FLY



2*5*10y FLY



IRS 주요 커브

FLY

구분	증가	전일대비
6m*9m*1y	-4.00	0.50
1*1.5*2y	-6.25	0.50
2*5*10y	-13.50	0.50
5*7*10y	-1.25	0.75